



【2023-02-15】

今日美元/人民币中间价报 6.8183，较上一个交易日上调 47bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

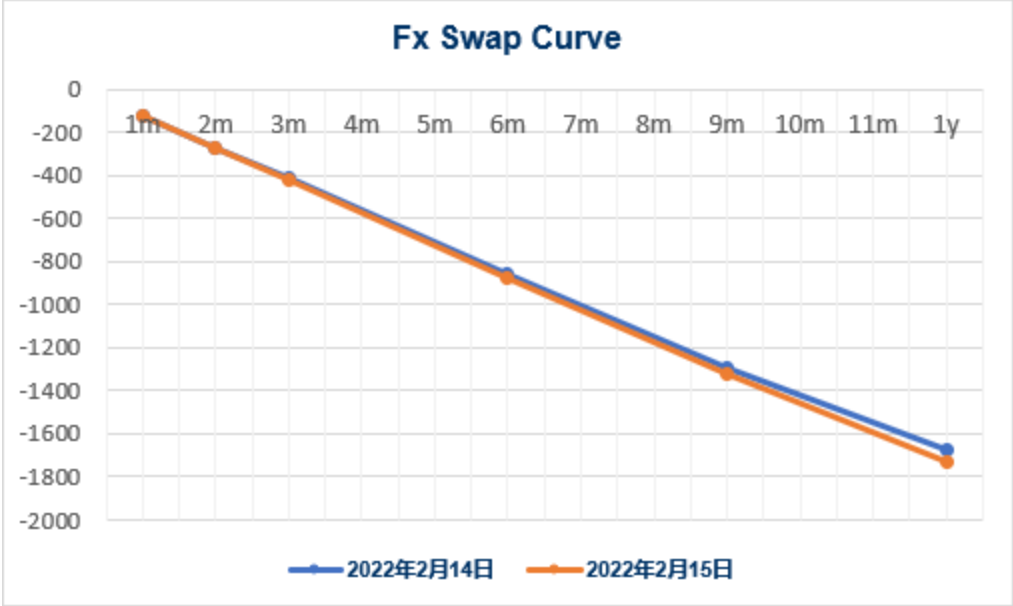
ON 成交在-4.5~-4.4 之间；TN 在-4.59~-4.55 之间来回成交；SN 早盘成交在-18.3~-17.56，午后成交在-17.68~-17.66。1W 从-32 买到-31.65，2W 成交在-62 附近；1S 成交在-127~-126 附近；2S 成交在-276~-273 附近；3S 从-421 买到-419。

中长期限，6S 从 876 给到-881；9S 从-1330 给到-1332；1Y 早盘反复成交在-1760~-1750，午后从-1742 买到-1735。

超长期限，2Y 成交在-2395。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-32	6.8419	0.05
2W	14	-62	6.8390	9
1M	28	-127	6.8324	-2
2M	59	-272	6.8179	3
3M	89	-418	6.8033	-4.7
6M	181	-872	6.7579	-11
9M	273	-1321	6.7130	-25
1Y	368	-1733	6.6718	-53
18M	549	-2220	6.6231	-120
2Y	832	-2400	6.6051	-150
3Y	1102	-2500	6.5951	-180
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8183	
CLOSING SPOT RATE			6.8451	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-145	-291.2	-745	-1194	-1606
2M		-146.2	-600	-1049	-1461
3M			-453.8	-902.8	-1314.8
6M				-449	-861
9M					-412



文 / Cathy He

联系人: Rafael Wang
邮箱: rafael.wang@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明:
以上所含及附加的所有信息（以下简称“信息”）仅用以提供信息，且为保密的和/或者专用的信息，其知识产权属于上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）或第三方，“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据，也不保证其完整性、时效性或准确性等要求，且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN